

**Aviso:** [2024-07-03 06:17] este documento é uma impressão do portal Ciência-IUL e foi gerado na data indicada. O documento tem um propósito meramente informativo e representa a informação contida no portal Ciência-IUL nessa data.

## João Pedro Vidal Nunes



### Professor Catedrático

Departamento de Finanças (IBS)

### Coordenador

BRU-Iscte - Business Research Unit (IBS)  
[Grupo de Finanças]

### Investigador Integrado

BRU-Iscte - Business Research Unit (IBS)  
[Grupo de Finanças]

## Contactos

<b>E-mail</b>	joao.nunes@iscte-iul.pt
<b>Gabinete</b>	D5.31
<b>Telefone</b>	217650526 (Ext: 220151)
<b>Cacifo</b>	103-A

## Qualificações Académicas

Universidade/Instituição	Tipo	Curso	Período
University of Warwick	Doutoramento	Gestão	2000
Instituto Superior de Economia e Gestão - UTL	Mestrado	Economia	1994
ISCTE-IUL - Instituto Superior Ciências Trabalho e da Empresa	Licenciatura	Organização e Gestão de Empresas	1990

## Atividades Letivas

Ano Letivo	Sem.	Nome da Unidade Curricular	Curso(s)	Coord.
2024/2025	2º	Investimentos	Licenciatura em Finanças e Contabilidade; Licenciatura em Gestão;	Sim
2024/2025	2º	Opções Exóticas	Mestrado em Matemática Financeira (ISCTE/FCUL);	Sim
2024/2025	1º	Dissertação em Matemática Financeira	Mestrado em Matemática Financeira (ISCTE/FCUL);	Sim
2024/2025	1º	Investimentos	Licenciatura em Finanças e Contabilidade; Licenciatura em Gestão;	Sim
2024/2025	1º	Modelos da Estrutura Temporal de Taxas de Juro	Mestrado em Matemática Financeira (ISCTE/FCUL);	Sim
2023/2024	2º	Modelação Financeira	Licenciatura em Matemática Aplicada e Tecnologias Digitais;	Sim
2023/2024	2º	Mercados de Taxa de Juro	Outro em Programa Aplicado Online em Corporate Finance;	Sim
2023/2024	2º	Investimentos	Licenciatura em Finanças e Contabilidade; Licenciatura em Gestão;	Sim
2023/2024	2º	Opções Exóticas	Mestrado em Matemática Financeira (ISCTE/FCUL);	Sim
2023/2024	1º	Teoria do Risco em Seguros Não-Vida	Mestrado em Matemática Financeira (ISCTE/FCUL);	Sim
2023/2024	1º	Dissertação em Matemática Financeira	Mestrado em Matemática Financeira (ISCTE/FCUL);	Sim
2023/2024	1º	Investimentos	Licenciatura em Finanças e Contabilidade; Licenciatura em Gestão;	Sim
2023/2024	1º	Modelos da Estrutura Temporal de Taxas de Juro	Mestrado em Matemática Financeira (ISCTE/FCUL);	Sim
2022/2023	2º	Dissertação em Matemática Financeira	Mestrado em Matemática Financeira (ISCTE/FCUL);	Sim
2022/2023	2º	Gestão de Activos e Passivos	Curso de Pós Graduação em Mercados e Riscos Financeiros;	Sim
2022/2023	2º	Mercados de Taxa de Juro	Outro em Programa Aplicado Online em Corporate Finance;	Sim
2022/2023	2º	Investimentos	Licenciatura em Finanças e Contabilidade; Licenciatura em Gestão;	Sim

2022/2023	2º	Opções Exóticas	Mestrado em Matemática Financeira (ISCTE/FCUL);	Sim
2022/2023	1º	Teoria do Risco em Seguros Não-Vida	Mestrado em Matemática Financeira (ISCTE/FCUL);	Sim
2022/2023	1º	Dissertação em Matemática Financeira	Mestrado em Matemática Financeira (ISCTE/FCUL);	Sim
2022/2023	1º	Investimentos II	Doutoramento em Finanças;	Não
2022/2023	1º	Investimentos	Licenciatura em Finanças e Contabilidade; Licenciatura em Gestão;	Sim
2022/2023	1º	Investimentos	Mestrado em Finanças;	Não
2022/2023	1º	Modelos da Estrutura Temporal de Taxas de Juro	Mestrado em Matemática Financeira (ISCTE/FCUL);	Sim
2021/2022	2º	Dissertação em Matemática Financeira	Mestrado em Matemática Financeira (ISCTE/FCUL);	Sim
2021/2022	2º	Mercados de Taxa de Juro	Outro em Programa Aplicado Online em Corporate Finance;	Sim
2021/2022	2º	Investimentos	Licenciatura em Finanças e Contabilidade; Licenciatura em Gestão;	Sim
2021/2022	2º	Opções Exóticas	Mestrado em Matemática Financeira (ISCTE/FCUL);	Sim
2021/2022	1º	Dissertação em Matemática Financeira	Mestrado em Matemática Financeira (ISCTE/FCUL);	Sim
2021/2022	1º	Investimentos	Licenciatura em Finanças e Contabilidade; Licenciatura em Gestão;	Sim
2021/2022	1º	Modelos da Estrutura Temporal de Taxas de Juro	Mestrado em Matemática Financeira (ISCTE/FCUL);	Sim
2020/2021	2º	Dissertação em Matemática Financeira	Mestrado em Matemática Financeira (ISCTE/FCUL);	Sim
2020/2021	2º	Gestão de Activos e Passivos	Curso de Pós Graduação em Mercados e Riscos Financeiros;	Sim
2020/2021	2º	Mercados de Taxa de Juro	Outro em Programa Aplicado Online em Corporate Finance;	Sim
2020/2021	2º	Investimentos	Licenciatura em Finanças e Contabilidade; Licenciatura em Gestão;	Sim
2020/2021	2º	Programação	Mestrado em Matemática Financeira (ISCTE/FCUL);	Sim
2020/2021	2º	Opções Exóticas	Mestrado em Matemática Financeira (ISCTE/FCUL);	Sim

2020/2021	2º	Cálculo Estocástico em Finanças I	Mestrado em Matemática Financeira (ISCTE/FCUL);	Sim
2020/2021	2º	Equações com Derivadas Parciais em Finanças	Mestrado em Matemática Financeira (ISCTE/FCUL);	Sim
2020/2021	2º	Cálculo Estocástico em Finanças II	Mestrado em Matemática Financeira (ISCTE/FCUL);	Sim
2020/2021	1º	Investimentos	Licenciatura em Finanças e Contabilidade; Licenciatura em Gestão;	Sim
2020/2021	1º	Investimentos Financeiros	Mestrado em Matemática Financeira (ISCTE/FCUL);	Sim
2020/2021	1º	Métodos Numéricos	Mestrado em Matemática Financeira (ISCTE/FCUL);	Sim
2020/2021	1º	Modelos da Estrutura Temporal de Taxas de Juro	Mestrado em Matemática Financeira (ISCTE/FCUL);	Sim
2020/2021	1º	Teoria da Medida	Mestrado em Matemática Financeira (ISCTE/FCUL);	Sim
2019/2020	2º	Dissertação em Matemática Financeira	Mestrado em Matemática Financeira (ISCTE/FCUL);	Sim
2019/2020	2º	Investimentos	Licenciatura em Finanças e Contabilidade; Licenciatura em Gestão;	Sim
2019/2020	2º	Programação	Mestrado em Matemática Financeira (ISCTE/FCUL);	Sim
2019/2020	2º	Opções Exóticas	Mestrado em Matemática Financeira (ISCTE/FCUL);	Sim
2019/2020	2º	Cálculo Estocástico em Finanças I	Mestrado em Matemática Financeira (ISCTE/FCUL);	Sim
2019/2020	2º	Equações com Derivadas Parciais em Finanças	Mestrado em Matemática Financeira (ISCTE/FCUL);	Sim
2019/2020	2º	Cálculo Estocástico em Finanças II	Mestrado em Matemática Financeira (ISCTE/FCUL);	Sim
2019/2020	1º	Investimentos	Licenciatura em Finanças e Contabilidade; Licenciatura em Gestão;	Sim
2019/2020	1º	Investimentos Financeiros	Mestrado em Matemática Financeira (ISCTE/FCUL);	Sim
2019/2020	1º	Métodos Numéricos	Mestrado em Matemática Financeira (ISCTE/FCUL);	Sim
2019/2020	1º	Modelos da Estrutura Temporal de Taxas de Juro	Mestrado em Matemática Financeira (ISCTE/FCUL);	Sim
2019/2020	1º	Teoria da Medida	Mestrado em Matemática Financeira (ISCTE/FCUL);	Sim

## Orientações

### • Teses de Doutoramento

#### - Em curso

	Nome do Estudante	Título/Tópico	Língua	Estado	Instituição
1	Domingos da Silva Ferreira	ANÁLISE DA PARIDADE PUT-CALL EM OPÇÕES SOBRE OS ÍNDICES DE ACÇÕES: PSI-20 E IBEX-35	Inglês	Em curso	ISCTE-IUL
2	Rui Manuel M dos Anjos Alpalhão	NACIONALIZAÇÕES, INDEMINIZAÇÕES E PRIVATIZAÇÕES EM PORTUGAL: ANÁLISE DAS TRANSFERÊNCIAS DE RIQUEZA E REESTRUTURAÇÕES EMPRESARIAIS	Inglês	Em curso	ISCTE-IUL
3	Paulo Miguel M Gama Gonçalves	A PREVISÃO DOS RETORNOS EM ACÇÕES UTILIZANDO VARIÁVEIS FUNDAMENTAIS: PORTUGAL (1989-1999)	Inglês	Em curso	ISCTE-IUL

#### - Terminadas

	Nome do Estudante	Título/Tópico	Língua	Instituição	Ano de Conclusão
1	Fernando Correia da Silva	Three Essays on Option Pricing	Inglês	ISCTE-IUL	2023
2	Mário Jorge Correia Fernandes	Three Essays on Modeling Energy Prices with Time-Varying Volatility and Jumps	--	ISCTE-IUL	2021
3	João Pedro Ruas	Three Essays on the Valuation of American-style Options	Inglês	ISCTE-IUL	2013
4	Luís Alberto Ferreira de Oliveira	Theoretical and Empirical Essays Onthe Heath-jarrow-morton Framework	--	ISCTE-IUL	--
5	Paulo Miguel Marques Gama Gonçalves	Essays on International Equity Markets	Inglês	ISCTE-IUL	--

### • Dissertações de Mestrado

#### - Terminadas

	Nome do Estudante	Título/Tópico	Língua	Instituição	Ano de Conclusão
1	André Filipe Assunção Damásio	Prémio de risco para futuros do VIX-squared sob o modelo de Eraker-Wu (2017)	Inglês	ISCTE-IUL	2023
2	Ana Marisa Silva Sousa	Calibração do Modelo de Jarrow e Yildirim (2003) para a determinação do preço das obrigações TIPS	Português	ISCTE-IUL	2023

3	Daniel Alexandre Velho Ferreira	Pricing na era pós-IBOR	Inglês	ISCTE-IUL	2022
4	Claudio Alberto Salinas Tejerina	O SPX e o VIX saltam simultaneamente?	Inglês	ISCTE-IUL	2021
5	João Luís Gomes Ferreira Campos Andrada	Modelização paramétrica da superfície de volatilidade implícita	Português	ISCTE-IUL	2018
6	Ricardo Manuel Santos Oliveira Tomaz	The Market Value of Corporate Votes: Another Approach.	Inglês	ISCTE-IUL	2017
7	João Miguel Sousa Machado Castilho Borges	Impacto da Política do Quantitative Easing num Portfólio de Investimento	Português	ISCTE-IUL	2017
8	Pedro Miguel Silva Prazeres	Essays on Options Pricing, with Applications on Interest Rates, Equities and Credit Derivatives	--	ISCTE-IUL	2017
9	Inês Sofia Morais Ferreira	Opções sobre commodities	Português	ISCTE-IUL	2016
10	Bruno Filipe Soares dos Santos Sousa	Credit Valuation Adjustment	Inglês	ISCTE-IUL	2016
11	Ricardo Nuno Santos Aleixo de Matos	Stochastic Volatility Jump-diffusion Models us time-changed levy Processes	Inglês	ISCTE-IUL	2014
12	Pedro Simões Oliveira	The corvolution method for pricing American options under levy processes	Inglês	ISCTE-IUL	2014
13	Igor Viktorovich Kravchenko	Barrier Option Pricing Via Heston Model	Inglês	ISCTE-IUL	2013
14	João Pedro Bento Ruas	Three Essays on the Valuation of American-Style Options	Inglês	ISCTE-IUL	2013
15	Sara Alexandra da Costa Veloso	O Modelo Fiscal de Avaliação de Prédios Urbanos e o Ciclo Económico do País	Português	ISCTE-IUL	2013
16	Jorge Miguel Fernandes Nascimento	Dimensão e especificação de volatilidades e correlações para lognormal LIBOR market models: uma avaliação empírica	Inglês	ISCTE-IUL	2004
17	Maria Isabel Lopes Soares	Kalman filtering of affine term structure models with macro state variables	Inglês	ISCTE-IUL	2004
18	Sofia Nú Oliveira	Empirical analysis of the primary market for range notes	Inglês	ISCTE-IUL	2003
19	Luís Alberto Ferreira de Oliveira	The quality option implicit in treasury bond futures contracts: a theoretical and empirical assessment	Inglês	ISCTE-IUL	2002

## • Projetos Finais de Mestrado

### - Terminadas

	<b>Nome do Estudante</b>	<b>Título/Tópico</b>	<b>Língua</b>	<b>Instituição</b>	<b>Ano de Conclusão</b>
1	Margarida Dinis Silvestre	Pateo Wine Bar & Heritage Shop	Inglês	ISCTE-IUL	2012
2	Sara Isabel Poço Ramos	Decomposição, Avaliação e Hedging de um Produto Estruturado	Português	ISCTE-IUL	2012
3	Tiago Miguel Vargas Tavares	Modelos de Taxa de Juro após a Crise de Crédito e Liquidez	Português	ISCTE-IUL	2012
4	Arne Neumann	Assembly and Preparation for the Derivative Market - A Convenience Comparison Between Financial Options and Futures with View to the Eurex and Liffe.	--	ISCTE-IUL	2011
5	William Hilebrand	The Valuation of Callable Defaultable Bonds.	--	ISCTE-IUL	2011
6	Iva Bagic	Singue and Combined Option Trading Strategies.	--	ISCTE-IUL	2011
7	Jorge Alexandre Rodrigues Domingues		--	ISCTE-IUL	2011
8	Luís Filipe Dôres Veiga		--	ISCTE-IUL	2011
9	Filipa Isabel Ferreira Alcaide	Covered Bond Market - Is Legislation Impact Measurable?	Inglês	ISCTE-IUL	2011
10	Maria da Graça Teixeira Duarte de Aguiar Câmara	O Efeito Smile - Uma Aplicação ao DAX.	Português	ISCTE-IUL	2010
11	Cláudia Patrícia Gonçalves Simões	Euro Área Inflation-Linked Bonds Market: Analysis and immunization abilities.	Português	ISCTE-IUL	2010
12	Diogo Monteiro da Costa Soares Justino	Hedging of Barrier Options.	Português	ISCTE-IUL	2010
13	Aloísio Bragança Gomes Will	Ambidiesel - Produção de Combustíveis Alternativos.	Português	ISCTE-IUL	2010
14	Fernando Manuel de Deus Infante	Basileia II: Análise das Implicações do Pilar 2 na Organização do Processo de Supervisão.	Português	ISCTE-IUL	2009
15	Carina Sofia Ferreira da Silva	O Mercado Organizado de CO2 - Oportunidade de Investimento e Melhoria do Ambiente Compatíveis?	Português	ISCTE-IUL	2009

## Total de Citações

**Web of Science®**

263

**Scopus**

240

## Publicações

### • Revistas Científicas

#### - Artigo em revista científica

1	Dias, J. C., Nunes, J. & Silva, F. C. (2024). Finite maturity caps and floors on continuous flows under the constant elasticity of variance process. <i>European Journal of Operational Research</i> . 316 (1), 361-385 - N.º de citações Google Scholar: 2
2	Fernandes, M. C, Dias, J. C. & Nunes, J. (2024). Performance comparison of alternative stochastic volatility models and its determinants in energy futures: COVID19 and Russia-Ukraine conflict features. <i>Journal of Futures Markets</i> . 44 (3), 343-383
3	Nunes, J. & Ruas, J. (2024). A note on the Gumbel convergence for the Lee and Mykland jump tests. <i>Finance Research Letters</i> . 59
4	Bravo, J. M. & Nunes, J. (2021). Pricing longevity derivatives via Fourier transforms. <i>Insurance: Mathematics and Economics</i> . 96, 81-97 - N.º de citações Web of Science®: 28 - N.º de citações Scopus: 24 - N.º de citações Google Scholar: 40
5	Fernandes, M. C, Dias, J. C. & Nunes, J. (2021). Modeling energy prices under energy transition: A novel stochastic-copula approach. <i>Economic Modelling</i> . 105 - N.º de citações Web of Science®: 6 - N.º de citações Scopus: 9 - N.º de citações Google Scholar: 12
6	Nunes, J., Ruas, J. & Dias, J. C. (2020). Early exercise boundaries for American-style knock-out options. <i>European Journal of Operational Research</i> . 285 (2), 753-766 - N.º de citações Web of Science®: 8 - N.º de citações Scopus: 7 - N.º de citações Google Scholar: 12
7	Dias, J. C., Nunes, J. & Cruz, A. (2020). A note on options and bubbles under the CEV model: Implications for pricing and hedging. <i>Review of Derivatives Research</i> . 23 (3), 249-272 - N.º de citações Web of Science®: 5 - N.º de citações Scopus: 4 - N.º de citações Google Scholar: 10
8	Nunes, J. P. V., Dias, J. C. & Ruas, J. P. (2020). The early exercise boundary under the jump to default extended CEV model. <i>Applied Mathematics and Optimization</i> . 82 (1), 151-181 - N.º de citações Web of Science®: 1 - N.º de citações Scopus: 2 - N.º de citações Google Scholar: 5
9	Dias, J. C. & Nunes, J. P. V. (2018). Universal recurrence algorithm for computing Nuttall, generalized Marcum and incomplete Toronto functions and moments of a noncentral $x_2$ random variable. <i>European Journal of Operational Research</i> . 265 (2), 559-570 - N.º de citações Web of Science®: 2 - N.º de citações Scopus: 1 - N.º de citações Google Scholar: 4



10	<p>Ruas, J. P., Nunes, J. P. V. &amp; Dias, J. C. (2016). In-out parity relations for American-style barrier options. <i>Journal of Derivatives</i>. 23 (4), 20-32</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- N.º de citações Web of Science®: 1</li> <li>- N.º de citações Scopus: 1</li> <li>- N.º de citações Google Scholar: 2</li> </ul>
11	<p>Nunes, J. P. V. &amp; Alcária, T. R. V. (2016). Valuation of forward start options under affine jump-diffusion models. <i>Quantitative Finance</i>. 16 (5), 727-747</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- N.º de citações Web of Science®: 3</li> <li>- N.º de citações Scopus: 2</li> </ul>
12	<p>Dias, J. C., Nunes, J. P. V. &amp; Ruas, J. P. (2015). Pricing and static hedging of european-style double barrier options under the jump to default extended CEV model. <i>Quantitative Finance</i>. 15 (12), 1995-2010</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- N.º de citações Web of Science®: 16</li> <li>- N.º de citações Scopus: 13</li> <li>- N.º de citações Google Scholar: 21</li> </ul>
13	<p>Nunes, J., Ruas, J. &amp; Dias, J. C. (2015). Pricing and static hedging of American-style knock-in options on defaultable stocks. <i>Journal of Banking and Finance</i>. 58, 343-360</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- N.º de citações Web of Science®: 16</li> <li>- N.º de citações Scopus: 13</li> <li>- N.º de citações Google Scholar: 22</li> </ul>
14	<p>Nunes, J. &amp; Prazeres, P. (2014). Pricing swaptions under multifactor gaussian HJM models. <i>Mathematical Finance</i>. 24 (4), 762-789</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- N.º de citações Web of Science®: 3</li> <li>- N.º de citações Scopus: 4</li> </ul>
15	<p>Oliveira, L., Nunes, J. &amp; Malcato, L. (2014). The performance of deterministic and stochastic interest rate risk measures: another question of dimensions?. <i>Portuguese Economic Journal</i>. 13 (3), 141-165</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- N.º de citações Web of Science®: 3</li> <li>- N.º de citações Scopus: 3</li> </ul>
16	<p>Ruas, J. P., Dias, J. C. &amp; Nunes, J. (2013). Pricing and static hedging of American-style options under the jump to default extended CEV model. <i>Journal of Banking and Finance</i>. 37 (11), 4059-4072</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- N.º de citações Web of Science®: 24</li> <li>- N.º de citações Scopus: 18</li> <li>- N.º de citações Google Scholar: 33</li> </ul>
17	<p>Oliveira, L., Curto, J. D. &amp; Nunes, J. P. (2012). The determinants of sovereign credit spread changes in the Euro-zone. <i>Journal of International Financial Markets, Institutions &amp; Money</i>. 22 (2), 278-304</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- N.º de citações Web of Science®: 57</li> <li>- N.º de citações Scopus: 58</li> </ul>
18	<p>Dias, J. C. &amp; Nunes, J. P. (2011). Pricing real options under the constant elasticity of variance diffusion. <i>Journal of Futures Markets</i>. 31 (3), 230-250</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- N.º de citações Web of Science®: 30</li> <li>- N.º de citações Scopus: 26</li> <li>- N.º de citações Google Scholar: 47</li> </ul>
19	<p>Nunes, J. P. V. (2011). American options and callable bonds under stochastic interest rates and endogenous bankruptcy. <i>Review of Derivatives Research</i>. 14 (3), 283-332</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- N.º de citações Web of Science®: 4</li> <li>- N.º de citações Scopus: 2</li> </ul>

20	Nunes, J. (2009). Pricing American Options under the Constant Elasticity of Variance Model and Subject to Bankruptcy. <i>Journal of Financial and Quantitative Analysis</i> . 44, 1231-1263 - N.º de citações Web of Science®: 33 - N.º de citações Scopus: 31
21	Nunes, J. P. V. & Oliveira, L. (2007). Multifactor and analytical valuation of treasury bond futures with an embedded quality option. <i>Journal of Futures Markets</i> . 27 (3), 275-303 - N.º de citações Web of Science®: 8
22	Nunes, J. P. V. (2006). Barrier options on spot LIBOR rates under multi-factor Gaussian HJM models. <i>Journal of Derivatives</i> . 14 (1), 61-81 - N.º de citações Scopus: 3
23	Nunes, J. P. V. (2004). Multifactor valuation of floating range notes. <i>Mathematical Finance</i> . 14 (2), 79-97 - N.º de citações Web of Science®: 15 - N.º de citações Scopus: 11
24	Nunes, J. P. V. (2004). A general equilibrium framework for the affine class of term structure models. <i>Portuguese Economic Journal</i> . 3 (1), 15-48
25	Nunes, J., Clewlow, L. & Hodges, S. (1999). Interest Rate Derivatives in a Duffie and Kan Model with Stochastic Volatility: An Arrow-Debreu Pricing Approach. <i>Review of Derivatives Research</i> . 3, 5-66 - N.º de citações Scopus: 8
26	Nunes, J. (1998). Interest Rate Options in a Duffie-Kan Model with Deterministic Volatility. <i>Portuguese Review of Financial Markets</i> . 1, 63-101

## • Livros e Capítulos de Livros

### - Autor de livro

1	Miguel, A., Mota, A., Barroso, C., Nunes, J., Lourenço, J., Oliveira, L....Alpalhão, R. (2019). <i>Investimentos Financeiros - Teoria e Prática</i> . Lisboa. Silabo.
2	Barroso, C., Mota, A., Oliveira, L., Nunes, J. & Inácio, P. (2015). <i>Finanças da Empresa: Teoria e Prática (edição revista e aumentada)</i> . Lisboa. Silabo.
3	Mota, A., Barroso, C., Nunes, J., Oliveira, L., Ferreira, M. & Inácio, P. (2015). <i>Finanças da Empresa: Teoria e Prática</i> . Lisboa. Sílabo.
4	Mota, A., Barroso, C., Nunes, J., Oliveira, L. & Ferreira, M. (2012). <i>Investimentos Financeiros: teoria e prática</i> . Portugal . Edições Sílabo .
5	Barroso, C., Mota, A., Nunes, J. & Ferreira, M. (2012). <i>Finanças da Empresa - Teoria e Prática</i> . Lisboa. Edições Silabo.
6	Barroso, C., Mota, A., Nunes, J. & Ferreira, M. (2010). <i>Finanças da Empresa _ Teoria e Prática</i> . Edições Silabo.
7	Oliveira, L., Mota, A., Barroso, C. & Nunes, J. (2009). <i>Investimentos Financeiros: Teoria e prática</i> . Lisboa/Portugal. Edições Sílabo.

### - Editor de livro

1	Mota, A., Barroso, C., Nunes, J., Miguel A. Ferreira & Oliveira, L. (2012). Finanças da Empresa: Teoria e Prática . Lisboa/Portugal. Sílabo.
2	Oliveira, L., Barroso, C., Nunes, J. & Miguel A. Ferreira (2011). Finanças da Empresa Teoria e Prática. Portugal. Sílabo.

## • Outras Publicações

### - Artigo sem avaliação científica

1	Oliveira, L. & Nunes, J. (2012). The Performance of Deterministic and Stochastic Interest Rate Risk Measures: Another Question of Dimension?. SSRN. 0-0
2	Oliveira, L. & Nunes, J. (2008). The Performance of Deterministic and Stochastic Interest Rate Risk Measures . SSRN. 0-0
3	Nunes, J. (1994). Gestão dos Riscos de Taxa de Juro e de Câmbio. Revista da Aula do Comércio. 15, 10-13
4	Mota, A. & Nunes, J. (1993). Avaliação de Aplicações Financeiras de Curto Prazo. Revista Iscte Gestão. 1, 13-15
5	Nunes, J. (1991). Indexante FIP versus Taxas APB. Revista de Gestão. 10, 23-27

### - Outras publicações

1	Ruas, J., Dias, J. C. & Nunes, J. (2017). Erratum to “Pricing and static hedging of American-style options under the jump to default extended CEV model” (Journal of Banking and Finance (2013) 37(11) (4059–4072) (S0378426613002896) (10.1016/j.jbankfin.2013.07.019)). Journal of Banking and Finance. 81, 20-23
2	Nunes, J., Pereira da Silva, C. & Cadete, J. (2003). The Immunisation of a Workers' Compensation Fund. Bulletin of the Portuguese Institute of Actuaries. 42, 11-39

## • Conferências/Workshops e Comunicações

### - Comunicação em evento científico

1	Fernandes, M. C, Dias, J. C. & Nunes, J. (2023). The Behaviour of Stochastic Volatility in Energy Futures Contracts with the COVID- 19 and the Russia–Ukraine Conflict. 12th International Conference of the Financial Engineering and Banking Society.
2	Dias, J. C., Nunes, J., Ruas, J. & Silva, F. C. (2023). Optimal Investment Decisions with Minimum Price Guarantees under the Constant Elasticity of Variance Process. 26th International Conference on Real Options.
3	Dias, J. C., Nunes, J., Ruas, J. & Silva, F. C. (2023). Optimal Investment Decisions with Minimum Price Guarantees under the Constant Elasticity of Variance Process. 12th International Conference of the Portuguese Finance Network.
4	Gloria, C. M., Dias, J. C., Ruas, J. & Nunes, J. (2022). The Interaction Between Equity-Based Compensation and Debt in Managerial Risk Choices. Paris Financial Management Conference.
5	Dias, J. C., Nunes, J. & Silva, F. C. (2022). Finite Maturity Caps and Floors on Continuous Flows under the CEV Process. Informs Annual Meeting.

6	Dias, J. C., Nunes, J. & Silva, F. C. (2022). Finite Maturity Caps and Floors on Continuous Flows under the CEV Process. 19th EUROPT Workshop on Advances in Continuous Optimization.
7	Fernandes, M. C, Dias, J. C. & Nunes, J. (2022). Modeling Energy Futures Prices Under Alternative Time-Varying Volatility Dynamics. 29th Annual Global Finance Conference.
8	Fernandes, M. C, Dias, J. C. & Nunes, J. (2021). Modeling Commodity Prices under Alternative Jump Processes and Fat Tails Dynamics. 11th International Conference of the Portuguese Finance Network.
9	Dias, J. C., Ildefonso, J., Nunes, J. & Ruas, J. (2021). Repeated Richardson Extrapolation and Static Hedging of Barrier Options under the JDCEV Model. 11th International Conference of the Portuguese Finance Network.
10	Fernandes, M. C, Dias, J. C. & Nunes, J. (2021). Modeling Electricity and Natural Gas Prices under the Electrification of Energy Firms. 14th Annual Meeting of the Portuguese Economic Journal.
11	Dias, J. C. & Nunes, J. (2018). Valuation of Lookback Options and Turbo Warrants on Defaultable Stocks. 10th International Conference of the Portuguese Finance Network.
12	Ruas, J., Nunes, J. & Dias, J. C. (2018). Early Exercise Boundaries for American-style Knock-Out Options. 10th World Congress of the Bachelier Finance Society.
13	Dias, J. C. & Nunes, J. (2018). Valuation of Lookback Options and Turbo Warrants on Defaultable Stocks. 12th Workshop on Statistics, Mathematics and Computation.
14	Dias, J. C., Laureano, L. & Nunes, J. (2017). Corporate Security Valuation under a Barrier Option Framework with State-Dependent Volatility. 5th Paris Financial Management Conference.
15	Leite, J., Dias, J. C. & Nunes, J. (2017). Computation of Three Discrete Distribution Mixtures of Continuous Distributions: Stability Analysis. 11th International Conference on Computational and Financial Econometrics.
16	Dias, J. C. & Nunes, J. (2017). Valuation of Lookback Options and Turbo Warrants on Defaultable Stocks. XXIII Congresso da Sociedade Portuguesa de Estatística.
17	Leite, J., Dias, J. C. & Nunes, J. (2017). Cálculo Computacional de Misturas Discretas de Distribuições Contínuas: Revisão do Método de Benton e Krishnamoorthy. XXIII Congresso da Sociedade Portuguesa de Estatística.
18	Dias, J. C. & Nunes, J. (2017). Valuation of Lookback Options and Turbo Warrants on Defaultable Stocks. 2nd International Conference on Computational Finance.
19	Dias, J. C. & Nunes, J. (2016). Valuation of Lookback Options and Turbo Warrants on Defaultable Stocks. 9th World Congress of the Bachelier Finance Society.
20	Nunes, J., Dias, J. C. & Ruas, J. (2016). The Early Exercise Boundary under the Jump to Default Extended CEV Model. 9th World Congress of the Bachelier Finance Society.
21	Nunes, J., Ruas, J. & Dias, J. C. (2014). Static Hedging and Early Exercise Boundaries for American-style Barrier Options. 8th World Congress of the Bachelier Finance Society.
22	Dias, J. C., Nunes, J. & Ruas, J. (2014). Pricing and Static Hedging of American-style Double Knock-In Options. Mathematical Finance Workshop: Stochastic Analysis and Numerical Approximations in Mathematical Finance.

23	Dias, J. C., Nunes, J. & Ruas, J. (2014). Pricing and Static Hedging of European-style Double Barrier Options under the Jump to Default Extended CEV Model. 8th International Conference of the Portuguese Finance Network.
24	Nunes, J. & Oliveira, L. (2013). The Performance of Deterministic and Stochastic Interest Rate Risk Measures: Another Question of Dimension?. 7th Annual Meeting of the Portuguese Economic Journal.
25	Dias, J.C., Nunes, J.P. & Ruas, J. P. (2013). In-Out Parity Relations and Early Exercise Boundaries for American-Style Barrier Options. FMA 17th European Conference.
26	Nunes, J. & Oliveira, L. (2013). The Performance of Deterministic and Stochastic Interest Rate Risk Measures: Another Question of Dimension?. FMA Europe 2013 Meeting.
27	Dias, J.C., Nunes, J.P. & Ruas, J. P. (2013). Pricing and Static Hedging of American Options under the Jump to Default Extended CEV Model. FMA 17th European Conference.
28	Nunes, J. & Ruas, J. (2012). The Implied Volatility Bias: A No-Arbitrage Approach for Short-Dated Options. EFMA 2012 Meeting.
29	Dias, J.C. & Nunes, J.P. (2012). Truncated Moments of a Noncentral $\chi^2$ Random Variable: An Extension of the Benton and Krishnamoorthy Approach. XX Congresso da Sociedade Portuguesa de Estatística.
30	Nunes, J. & Prazeres, P. (2012). Pricing Swaptions under Multifactor Gaussian HJM Models. SIAM Conference on Financial Mathematics and Engineering.
31	Dias, J.C., Nunes, J.P. & Ruas, J. P. (2012). Pricing and Static Hedging of American Options under the Jump to Default Extended CEV Model. INFORMS Annual Meeting.
32	Dias, J.C. & Nunes, J.P. (2012). The Valuation of Double Barrier Options under Multifactor Pricing Models. Mathematical Finance Days Conference.
33	Dias, J.C. & Nunes, J.P. (2012). Pricing Double Barrier Options under the CEV Process: A Speed-Accuracy Comparison of Alternative Methods. 7th World Congress of the Bachelier Finance Society.
34	Dias, J.C. & Nunes, J.P. (2012). The Valuation of Double Barrier Options under Multifactor Pricing Models. 7th International Conference of the Portuguese Finance Network.
35	Dias, J.C. & Nunes, J.P. (2012). The Valuation of Double Barrier Options under Multifactor Pricing Models. SIAM Conference on Financial Mathematics & Engineering.
36	Nunes, J. & Prazeres, P. (2012). Pricing Swaptions under Multifactor Gaussian HJM Models. Mathematical Finance Days 2012 Meeting.
37	Dias, J.C. & Nunes, J.P. (2011). Double Barrier Options Valuation under Multifactor Pricing Models. 21st Annual Derivatives Securities and Risk Management Conference.
38	Dias, J.C. & Nunes, J.P. (2011). The Valuation of Double Barrier Options under Multifactor Pricing Models. International Conference on Mathematical Finance and Economics.
39	Dias, J.C. & Nunes, J.P. (2010). Double Barrier Options Valuation under Multifactor Pricing Models. 6th World Congress of the Bachelier Finance Society.

40	Dias, J.C. & Nunes, J.P. (2008). Pricing Real Options under the CEV Diffusion. 12th International Conference on Real Options.
41	Dias, J.C. & Nunes, J.P. (2008). Pricing Real Options under the CEV Diffusion. 5th International Conference of the Portuguese Finance Network.

## Cargos de Gestão Académica

Membro (Docente) (2023 - 2025)  
Unidade/Área: Plenário do Conselho Científico

Director (2023 - 2025)  
Unidade/Área: [B76] Matemática Financeira (ISCTE/FCUL)

Coordenador (2022 - 2023)  
Unidade/Área: [0332] Mercados e Riscos Financeiros

Membro (Docente) (2021 - 2023)  
Unidade/Área: Conselho Geral

Coordenador (2021 - 2025)  
Unidade/Área: Grupo de Finanças

Director (2021 - 2023)  
Unidade/Área: [B76] Matemática Financeira (ISCTE/FCUL)

Coordenador (2021)  
Unidade/Área: [APCF] Programa Aplicado Online em Corporate Finance

Coordenador (2020 - 2021)  
Unidade/Área: [0332] Mercados e Riscos Financeiros

Director (2019 - 2021)  
Unidade/Área: [B76] Matemática Financeira (ISCTE/FCUL)

Membro (Docente) (2018 - 2022)  
Unidade/Área: Plenário da Comissão Científica

Membro (Docente) (2018 - 2022)  
Unidade/Área: Comissão Científica

Coordenador (2018 - 2021)  
Unidade/Área: Grupo de Finanças

Membro (2017 - 2021)  
Unidade/Área: Conselho Geral

Director (2017 - 2019)  
Unidade/Área: [B76] Matemática Financeira (ISCTE/FCUL)

Coordenador de ECTS (2015 - 2018)  
Unidade/Área: Departamento de Finanças

Director (2015 - 2017)  
Unidade/Área: [B76] Matemática Financeira (ISCTE/FCUL)

Sub-diretor (2014 - 2018)  
Unidade/Área: Departamento de Finanças

Membro (Docente) (2014 - 2018)  
Unidade/Área: Plenário da Comissão Científica

Membro (Docente) (2014 - 2018) Unidade/Área: Comissão Científica
Director (2013 - 2015) Unidade/Área: [B76] Matemática Financeira (ISCTE/FCUL)
Coordenador de ECTS (2012 - 2015) Unidade/Área: Departamento de Finanças
Director (2011 - 2013) Unidade/Área: [B76] Matemática Financeira (ISCTE/FCUL)
Director (2011 - 2013) Unidade/Área: [BPG004] Mercados e Activos Financeiros
Membro (Docente) (2010 - 2014) Unidade/Área: Plenário do Conselho Científico
Director (2010 - 2011) Unidade/Área: [BPG004] Mercados e Activos Financeiros
Director (2010 - 2011) Unidade/Área: [B76] Matemática Financeira (ISCTE/FCUL)
Presidente (2010 - 2014) Unidade/Área: Comissão Científica
Director (2010 - 2014) Unidade/Área: Departamento de Finanças
Membro (Docente) (2010 - 2014) Unidade/Área: Plenário da Comissão Científica
Membro (Docente) (2010 - 2014) Unidade/Área: Comissão Científica